

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

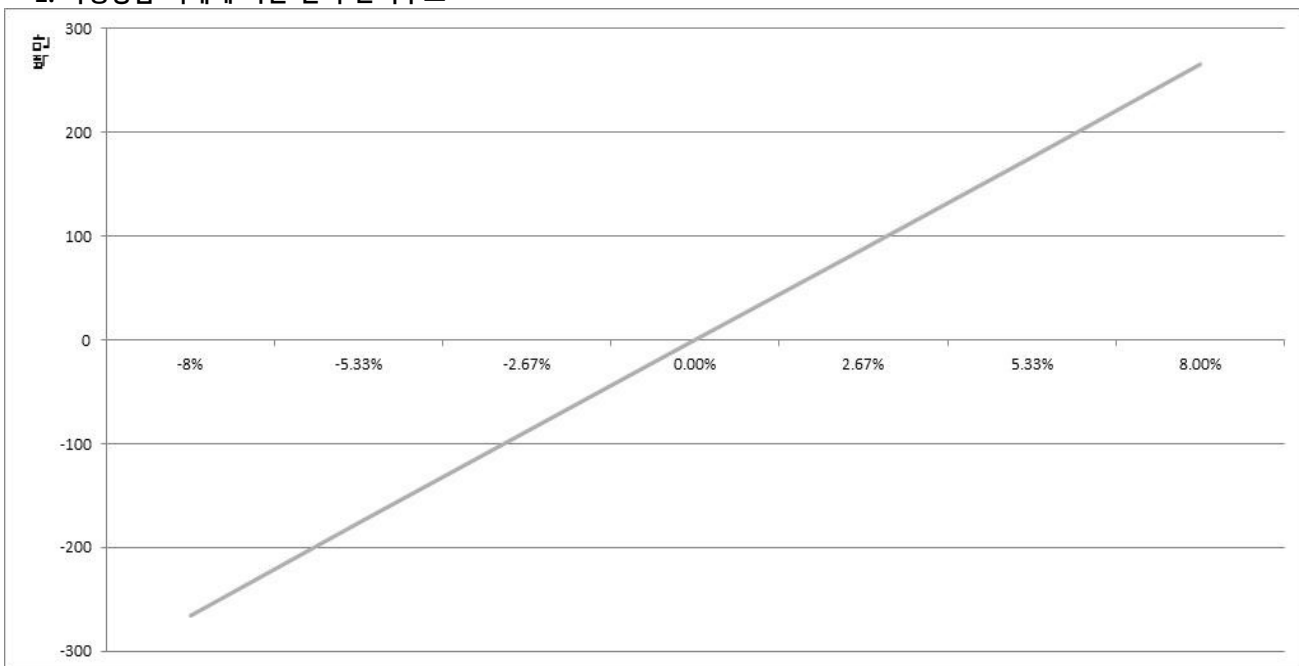
공시일: 2021-09-10

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	3,055	13,644	-10,589	장내
누계	주가지수	선물	5,091	0	5,091	장내
신규	주식	주식	10,573	84	10,488	장내
누계	주식	주식	44,540	0	44,540	장내
합계			49,631	0	49,631	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

406

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

3,842

펀드명 : 트러스트코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

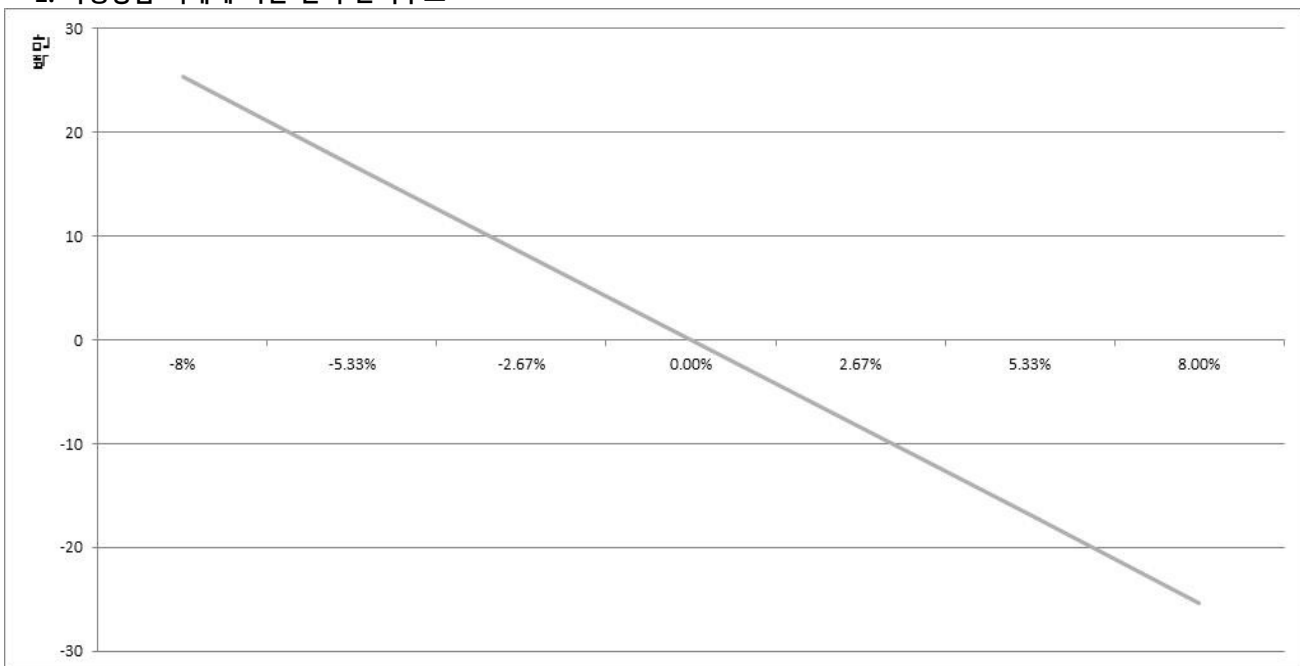
공시일: 2021-09-10

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	15,445	15,445	0	장내
누계	주가지수	선물	0	15,445	-15,445	장내
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	18,050	0	18,050	장내
합계			18,050	15,445	2,605	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

1,211

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

764

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

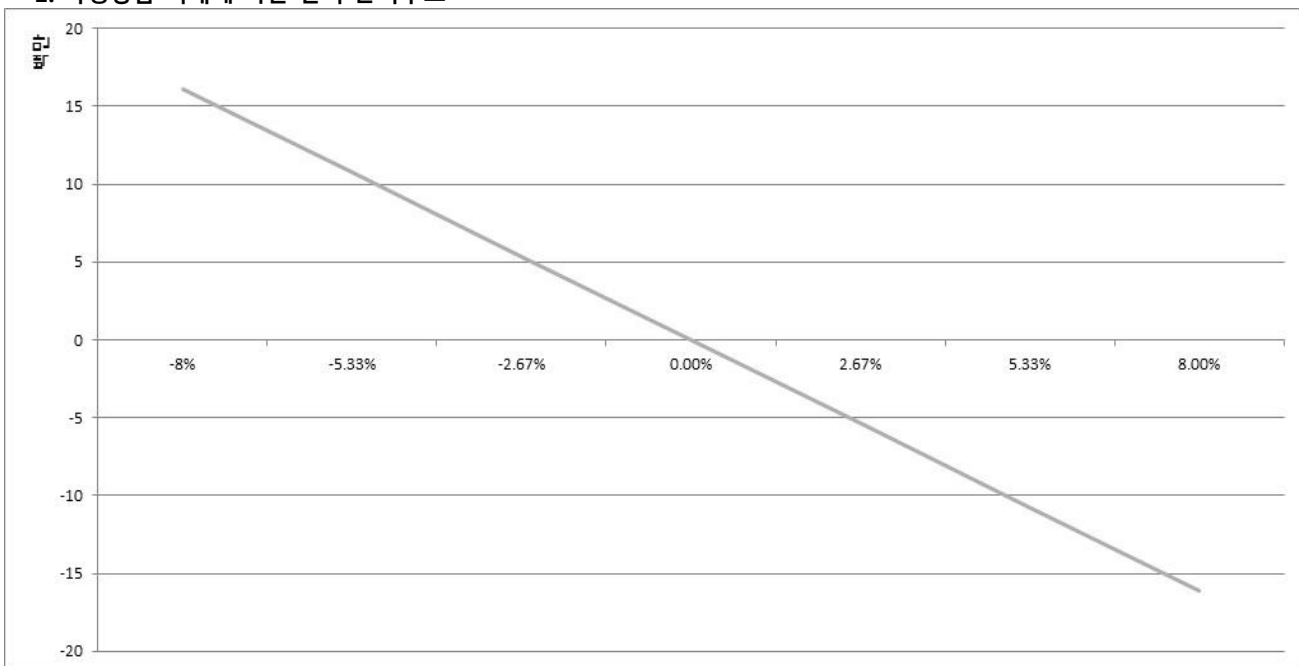
공시일: 2021-09-10

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	27	31	-4	장내
누계	주식	주식	5,054	1,033	4,021	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	402	-402	장내
합계			5,054	1,435	3,620	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

17

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

308